



MIXTA OPTIMA 30 (MOB)

Risikokennzahlen

1 Jahr	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	5.56 %	3.19 %	1.35 %	1.14	-1.47	0.82	-1.02 %	-3.07 %	2.00
MIXTA OPTIMA 30 II	5.62 %	3.19 %	1.35 %	1.16	-1.43	0.82	-0.96 %	-3.05 %	2.00
MO30 Customised	7.63 %	3.97 %	-	1.44	-	-	-	-3.62 %	2.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2023 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

3 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	-0.61 %	5.73 %	1.97 %	-0.44	0.18	0.77	-0.21 %	-12.51 %	21.00
MIXTA OPTIMA 30 II	-0.57 %	5.74 %	1.96 %	-0.43	0.20	0.77	-0.17 %	-12.49 %	21.00
MO30 Customised	-1.08 %	7.31 %	-	-0.41	-	-	-	-16.11 %	21.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2021 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

5 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	2.00 %	6.51 %	1.82 %	0.01	-0.09	0.84	-0.05 %	-12.51 %	21.00
MIXTA OPTIMA 30 II	2.02 %	6.51 %	1.82 %	0.02	-0.07	0.84	-0.02 %	-12.49 %	21.00
MO30 Customised	2.07 %	7.53 %	-	0.02	-	-	-	-16.11 %	21.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2019 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

10 Jahre	Return	Volatilität	Tracking Error	Sharpe Ratio	Information Ratio	Beta	Jensen Alpha	Max. kumulierter Verlust	Erholungsdauer
MIXTA OPTIMA 30 I	2.97 %	5.65 %	1.52 %	0.19	-0.41	0.88	-0.38 %	-12.51 %	21.00
MIXTA OPTIMA 30 II	2.98 %	5.65 %	1.52 %	0.19	-0.40	0.88	-0.37 %	-12.49 %	21.00
MO30 Customised	3.55 %	6.28 %	-	0.26	-	-	-	-16.11 %	21.00

Beobachtungszeitraum: 01.07.2014 bis 30.06.2024 Berechnungsbasis: monatlich

Risikofreier Zinssatz: 1.89 % (Libor CHF 3 Monate)

Angaben ohne Gewähr

Kennzahl	Berechnung	Beschreibung
Volatilität	$\sqrt{\text{Varianz}}$	Durchschnittliche Schwankungen der absoluten Rendite um ihren Mittelwert
Sharpe-Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.}}{\text{Volatilität Portfolio}}$	Absolute Überschussrendite pro Einheit eingegangenem Gesamtrisiko
Tracking Error	Standardabweichung (Rendite Portfolio p.a. – Rendite Benchmark p.a.)	Durchschnittliche Schwankung der Portfoliorendite um die Benchmarkrendite (Volatilität der relativen Rendite = aktives Risiko) Tracking Error zeigt an, wie benchmarknah ein Vermögen verwaltet wird
Information Ratio	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{Rendite Benchmark p.a.}}{\text{Tracking Error}}$	Mehr- oder Minderrendite pro eingegangenem aktiven Risiko
Beta-Faktor	$\frac{\text{Kovarianz zwischen Rendite Portfolio und Rendite Benchmark}}{\text{Varianz Rendite Benchmark}}$	Übernommenes Marktrisiko / Sensibilität auf Preisveränderungen des Marktes
Jensen-Alpha	$\frac{\text{Rendite Portfolio p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.}}{-\beta \times (\text{Rendite Benchmark p.a.} - \text{risikoloser Zinssatz p.a.})}$	Durchschnittliche risikobereinigte Mehr- oder Minderrendite
Maximum Drawdown (maximaler kumulierter Verlust)	$\frac{\text{Tiefster Portfoliowert nach Kurseinbruch} - \text{Höchster Portfoliowert vorher}}{\text{Höchster Portfoliowert vorher}}$	Maximaler Gesamtverlust innerhalb eines Betrachtungszeitraumes unabhängig von zwischenzeitlichen teilweisen Erholungen
Recovery Period (Erholungsdauer)	$\frac{\text{Datum Wiedererreichung Höchster Portfoliowert} - \text{Datum Tiefster Portfoliowert}}{\text{nach Kurseinbruch gemäss gewählter Periode bei Maximum Drawdown}}$	Zeitdauer bis zur Kompensation des vorangehenden Maximalverlustes
Modified Duration	$\frac{\text{Restlaufzeitgewichteter Barwert der Obligation}}{\text{Barwert der Obligation}}$	Sensitivitätsmass auf Veränderungen des Zinsniveaus